

Fecha de Publicación: 20 de julio de 2013

Fecha de Información: 18 de julio de 2013 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1397,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupa y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 302,6 | 283,0 | 32,8 | 40,8 | 14,6 | 26,2 | 235,6 |
| 15-35 | 304,0 | 588,3 | 457,6 | 71,0 | 43,7 | 146,0 | 87,0 |
| 36-60 | 113,6 | 42,7 | 0,0 | 0,0 | 22,7 | 93,6 | 20,0 |
| 61-90 | 2,1 | 4,0 | 0,0 | 0,0 | 4,0 | 2,1 | 0,0 |
| 91-180 | 58,2 | 35,5 | 25,0 | 0,0 | 10,5 | 58,2 | 0,0 |
| >180 | 0,7 | 5,6 | 0,0 | 0,0 | 5,6 | 0,7 | 0,0 |
| Total | 781,3 | 959,1 | 515,4 | 111,8 | 101,1 | 326,9 | 342,6 |

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| Rango | Sector Financiero* | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 2,8 % | 2,8 % | 0,4 % | 2,4 % |
| 15-35 | 3,7 % | 3,7 % | 3,7 % | 3,7 % |
| 36-60 | 3,7 % | 4,3 % | 3,9 % | 3,9 % |
| 61-90 | - | 4,4 % | 3,8 % | 4,2 % |
| 91-180 | - | 3,9 % | 3,5 % | 3,7 % |
| >180 | - | 4,0 % | 3,4 % | 3,9 % |
| Total | 3,1 % | 3,7 % | 3,3 % | 3,4 % |

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sectores | 15 al 19 de julio | | | | | | | | 22 al 26 de julio | | | | 29 de jul. al 2 de agosto | | | |
|---------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|------------|------------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|---------------------------|--|--|--|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | | | | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | | | | |
| Sector Financiero** | 102 | 134 | 3692 | 3393 | 19 | 115 | 2937 | 3175 | 5 | 61 | 1826 | 2393 | | | | |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2022 | 1500 | 0 | 0 | 1908 | 1089 | 0 | 0 | 1350 | 518 | | | | |
| Otros | 134 | 102 | 539 | 1361 | 115 | 19 | 463 | 1044 | 61 | 5 | 311 | 575 | | | | |
| Total | 236 | 236 | 6254 | 6254 | 134 | 134 | 5307 | 5307 | 66 | 66 | 3487 | 3487 | | | | |

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.